

HSBC ETFs PLC

HSBC BLOOMBERG GLOBAL SUSTAINABLE AGGREGATE 1-3 YEAR BOND UCITS ETF

Monatlicher Bericht 31 Dezember 2022 | HGGA GY



Anlageziel

Der Fonds strebt an, die Erträge des Bloomberg MSCI Global Aggregate 1-3 SRI Carbon ESG-Weighted Index (der „Index“) so genau wie möglich nachzubilden. Der Fonds investiert in Anleihen von im Index enthaltenen staatlichen Emittenten oder baut ein Engagement in diesen auf. Der Fonds erfüllt die Voraussetzungen von Artikel 8 der Offenlegungsverordnung.



Anlagestrategie

Der Index ist ein Teilindex des Bloomberg Global Aggregate 1-3 Year Index (der Hauptindex) und setzt sich aus festverzinslichen Investment-Grade-Anleihen mit einer Laufzeit von 1 bis 3 Jahren von Emittenten aus Industrie- und Schwellenländern zusammen, wie vom Indexanbieter definiert. Der Index strebt eine Reduzierung der Kohlenstoffemissionen und eine Verbesserung des MSCI Environmental Social & Governance Research-Rating im Vergleich zum Hauptindex an. Der Fonds wird passiv verwaltet und wendet eine Anlagetechnik an, die als „Optimierung“ bezeichnet wird. Diese Technik zielt darauf ab, den Renditeunterschied zwischen dem Fonds und dem Index zu minimieren, indem beim Aufbau des Portfolios der Tracking Error und die Handelskosten berücksichtigt werden. Es können Umstände bestehen, in denen es für den Fonds nicht möglich ist, in alle Bestandteile des Index zu investieren. Der Fonds kann bis zu 30 % in Total Return Swaps, bis zu 30 % in am CIBM gehandelte Wertpapiere und bis zu 10 % in andere Fonds, einschließlich HSBC-Fonds, investieren. Eine vollständige Beschreibung der Anlageziele und des Einsatzes von Derivaten finden Sie im Prospekt.



Hauptrisiken

- Der Wert der Fondsanteile kann sowohl steigen als auch fallen und das in den Fonds investierte Kapital kann stets gefährdet sein.
- Der Fonds investiert in Anleihen, deren Wert im Allgemeinen sinkt, wenn die Zinsen steigen. Dieses Risiko ist in der Regel umso größer, je länger die Laufzeit einer Rentenanlage und je höher die Bonität ist. Es kann vorkommen, dass die Emittenten bestimmter Anleihen nicht mehr bereit oder in der Lage sind, Zahlungen auf ihre Anleihen zu leisten, und in Verzug geraten. Notleidende Anleihen können schwer verkäuflich oder wertlos werden.
- Wenn der Fonds anstrebt, die Indexperformance durch das Halten einzelner Wertpapiere nachzubilden, gibt es keine Garantie, dass seine Zusammensetzung oder Performance zu jeder Zeit genau derjenigen des Zielindex entsprechen wird („Tracking Error“).

Anteilklasse and Tracking Error Details

Wesentliche Kennzahlen	
NAV je Anteil	USD 9,98
Rückzahlungsrendite	3,57%
Fondsfakten	
UCITS V-konform	Ja
Behandlung von Dividenden	Thesaurierend
Handel	Täglich
Bewertungstermin	23:00 Irland
Basiswährung der Anteilklasse	USD
Domizil	Irland
Auflegungsdatum	13 Januar 2022
Fondsvermögen	USD 79.982.775
Benchmark	100% Bloomberg MSCI Global Aggregate 1-3 SRI Carbon ESG-Weighted Index
Fondsmanager	Sebastien Faucher Amnita Sanyal Richard Jenkins

Gebühren und Kosten	
Mindestbetrag bei Erstanlage	USD 1
Laufende Kostenquote ¹	0,180%
Codes	
ISIN	IE000XGNMWE1
WKN	A3DM2C
Bloomberg-Ticker	HAGG LN

¹Laufende Kostenquote, basiert auf Kosten über ein Jahr. Die Quote beinhaltet jährliche Verwaltungsgebühren und zugrunde liegende Transaktionskosten. Dieser Wert kann von Zeit zu Zeit variieren.

Die frühere Wertentwicklung lässt keine Vorhersagen für die künftige Wertentwicklung zu. Die dargestellte Wertentwicklung basiert auf Netto-Inventarwerten. Ein Ausgabeaufschlag und Ihr Depotpreis (soweit diese anfallen) sind in der Darstellung nicht berücksichtigt und wirken sich negativ auf die Wertentwicklung der Anlage aus. Bei einer Anlagesumme von EUR 1.000 ist für die Anschaffung ein Ausgabeaufschlag in der Höhe von z.B. 5% zu berücksichtigen. Die dargestellte Wertentwicklung verringert sich in diesem Beispiel um EUR 50. Zusätzlich fällt ein jährliches Entgelt für die Verwahrung und Verwaltung an. Die tatsächlichen Entgelte ergeben sich aus dem Preis- und Leistungsverzeichnis Ihrer Bank.

Dies ist eine Marketingkommunikation. Bitte lesen Sie den Prospekt und KIID, bevor Sie abschließende Anlageentscheidungen treffen. Die bisherige Wertentwicklung dieser Anteilklasse darf nicht abgebildet werden, da der erforderliche Mindestzeitraum von zwölf Monaten noch nicht vorhanden ist.

Quelle: HSBC Asset Management, Daten zum 31 Dezember 2022

Wertentwicklung (%)	YTD	1 Monat	3 Monate	6 Monate	1 Jahr	3 Jahre annualisiert	5 Jahre annualisiert	Seit Auflegung
Fonds	--	--	--	--	--	--	--	--
Benchmark	--	--	--	--	--	--	--	--

Rollierende Wertentwicklung (%)	31/12/21- 31/12/22	31/12/20- 31/12/21	31/12/19- 31/12/20	31/12/18- 31/12/19	31/12/17- 31/12/18
Fonds	--	--	--	--	--
Benchmark	--	--	--	--	--

Klimabilanz	Fonds	Benchmark	MSCI ESG Score	ESG-Score	E	S	G
Kohlenstoff-intensität	203,67	274,60	Fonds	6,4	5,8	7,1	6,3
Die Kohlenstoffintensität misst die Menge der Kohlenstoffemissionen eines Unternehmens (Tonnen CO ² e/Mio. USD) Quelle: Trucost			Benchmark	6,0	5,4	6,9	6,1

3 Jahre Risikokennzahlen	Fonds	Benchmark	5 Jahre Risikokennzahlen	Fonds	Benchmark
Volatilität	--	--	Volatilität	--	--
Sharpe ratio	--	--	Sharpe ratio	--	--
Tracking error	--	--	Tracking error	--	--
Information ratio	--	--	Information ratio	--	--

Kennzahlen Renten	Fonds	Benchmark	Relativ
Anzahl der Positionen (ohne Kasse)	273	5.765	--
Durchschnittlicher Kupon	1,40	1,83	-0,43
Rendite im ungünstigsten Fall (Yield to Worst)	3,56%	3,60%	-0,04%
Optionsbereinigte Duration	1,88	1,89	-0,01
Modifizierte Duration im ungünstigsten Fall	1,88	1,89	-0,01
Optionsbereinigte Spread-Duration	1,92	1,93	0,00
Durchschnittliche Restlaufzeit	1,95	1,97	-0,01
Durchschnittliches Rating	AA/AA-	AA/AA-	--

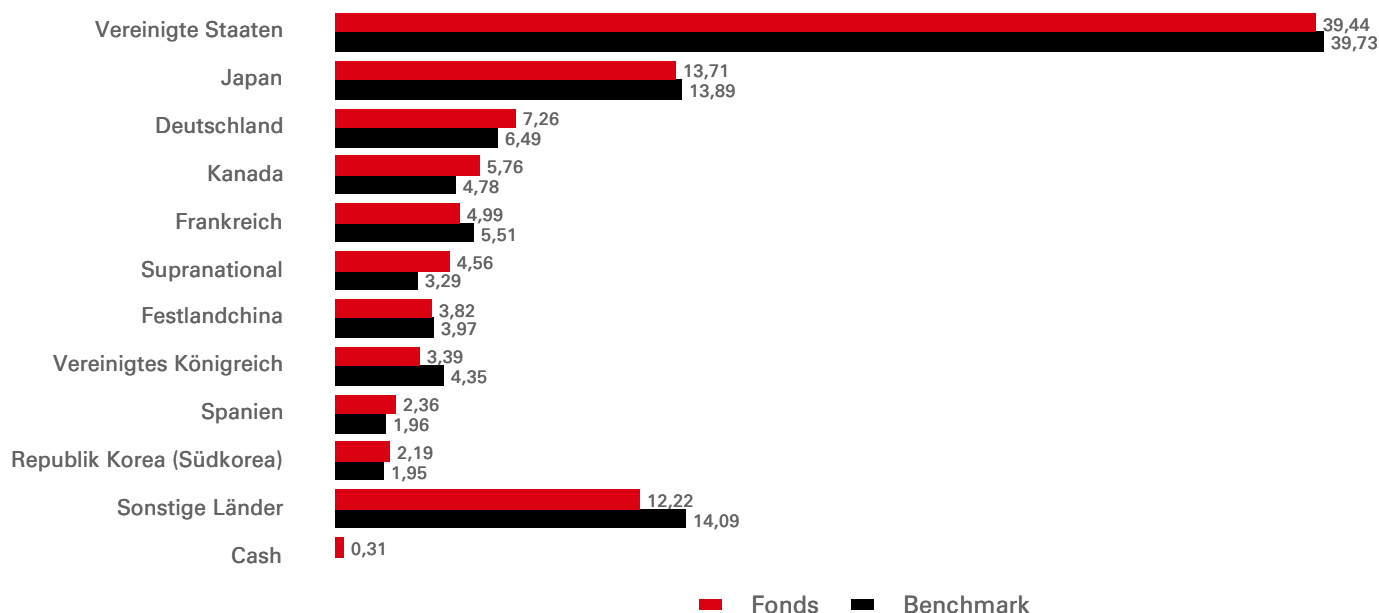
Kreditbeurteilung (%)	Fonds	Benchmark	Relativ	Restlaufzeiten (Optionsbereinigte Duration)	Fonds	Benchmark	Relativ
AAA	48,19	47,14	1,05	0 - 6 Monate	0,00	0,00	0,00
AA	14,49	14,83	-0,34	6months - 1 years	0,01	0,00	0,01
A	29,68	27,66	2,02	1 years - 1.5 years	0,33	0,35	-0,02
BBB	7,29	10,37	-3,07	1.5 years - 2 years	0,40	0,43	-0,03
Ohne Rating	0,04	--	0,04	2 years - 2.5 years	0,62	0,54	0,08
Cash	0,31	--	0,31	2.5 years - 4 years	0,52	0,57	-0,05
				Gesamtsumme	1,88	1,89	-0,01

Die frühere Wertentwicklung lässt keine Vorhersagen für die künftige Wertentwicklung zu. Die dargestellte Wertentwicklung basiert auf Netto-Inventarwerten. Ein Ausgabeaufschlag und Ihr Depotpreis (soweit diese anfallen) sind in der Darstellung nicht berücksichtigt und wirken sich negativ auf die Wertentwicklung der Anlage aus. Bei einer Anlagesumme von EUR 1.000 ist für die Anschaffung ein Ausgabeaufschlag in der Höhe von z.B. 5% zu berücksichtigen. Die dargestellte Wertentwicklung verringert sich in diesem Beispiel um EUR 50. Zusätzlich fällt ein jährliches Entgelt für die Verwahrung und Verwaltung an. Die tatsächlichen Entgelte ergeben sich aus dem Preis- und Leistungsverzeichnis Ihrer Bank.
 Quelle: HSBC Asset Management, Daten zum 31 Dezember 2022

Währung – Allokation

(%)	Fonds	Benchmark	Relativ
USD	46,80	46,87	-0,07
EUR	22,08	22,08	0,00
JPY	13,21	13,21	0,00
GBP	3,80	3,80	0,00
CAD	3,50	3,49	0,00
CNY	3,32	3,31	0,01
KRW	1,71	1,68	0,02
AUD	1,70	1,70	0,00
SEK	0,82	0,81	0,01
CHF	0,48	0,48	0,00
Sonstige Währungen	2,59	2,56	0,03

Geografische Allokation (%)



Sektorallokation (%)

	Fonds	Benchmark	Relativ
Staatsanleihen	67,93	65,81	2,12
Finanzdienstleistungen	11,50	10,56	0,93
Supranational	4,56	3,29	1,26
Agenturen	4,24	5,90	-1,66
Gedeckt	3,17	3,19	-0,02
LOCAL AUTHORITY	1,88	2,85	-0,98
Nichtzyklische Konsumgüter	1,51	1,65	-0,13
Zyklische Konsumgüter	1,36	1,17	0,20
Technologie	0,86	0,96	-0,10
Staatsanleihen	0,85	0,66	0,19
Sonstige Sektoren	1,84	3,95	-2,11
Cash	0,31	--	0,31

Top 10 Positionen	Gewichtung (%)
US TREASURY N/B 0,250 15/03/24	2,02
US TREASURY N/B 0,375 15/09/24	1,93
US TREASURY N/B 0,750 15/11/24	1,60
US TREASURY N/B 0,875 31/01/24	1,48
US TREASURY N/B 1,750 31/12/24	1,42
US TREASURY N/B 1,000 15/12/24	1,41
BUNDESUBL-179 0,000 05/04/24	1,33
US TREASURY N/B 0,250 15/05/24	1,18
US TREASURY N/B 0,375 15/08/24	1,17
JAPAN GOVT 5-YR 0,100 20/12/24	1,15

Bei den zehn größten Positionen sind Zahlungsmittel und Zahlungsmitteläquivalente sowie Geldmarktfonds nicht berücksichtigt.

Name der Börse	Notierungstag	Handels- währung	Handels-zeiten	Bloomberg- Ticker	Reuters RIC	iNAV Bloomberg	iNAV Reuters
LONDON STOCK EXCHANGE	14 Jan 2022	USD	--	HAGG LN	HAGG.L	HAGUSDIV	HAGGUSDINA V=SOLA
LONDON STOCK EXCHANGE	14 Jan 2022	GBP	--	HAGS LN	HAGS.L	HAGGBPIV	HAGSGBPNAV =SOLA
NYSE EURONEXT - EURONEXT PARIS	14 Jan 2022	EUR	--	HAGG FP	HAGG.PA	HAGEURIV	HAGGEURNAV =SOLA
BORSA ITALIANA SPA	18 Jan 2022	EUR	--	HAGG IM	HAGG.MI	HAGEURIV	HAGGEURNAV =SOLA
DEUTSCHE BOERSE AG-XETRA	18 Jan 2022	EUR	--	HGGA GY	HGGA.DE	HAGEURIV	HAGGEURNAV =SOLA

Top 10 Emittenten mit der geringsten Kohlenstoffintensität

Fonds	Kohlenstoff- intensität (Tonnen CO ² /Mio. USD Umsatz)	Benchmark	Kohlenstoff- intensität (Tonnen CO ² /Mio. USD Umsatz)
DNBNO 0.375 11/14/23	0,69	SBAB 0,5 05/13/25 EMTN	0,14
EQBCN 0.01 09/16/24	1,44	SBAB 0,375 02/16/24 EMTN	0,14
SHBASS 1.5 12/03/24 1589	1,55	BDN 4,1 10/01/24	0,23
NRWBK 0.375 02/10/25 EMTN	1,61	MGNLN V3,875 07/20/49	0,25
INTNED V0.125 11/29/25	1,70	AMG 3,5 08/01/25	0,30
DANBNK V0.976 09/10/25 144A	1,98	SRENVX V2,6 PERP	0,33
BYLAN 1 12/20/24 EMTN	2,00	SRENVX V4,25 PERP	0,33
NDASS 1 09/18/24 5534	2,09	SRENVX V4,5 09/11/44	0,33
PFG 0.75 04/12/24 144A	2,39	SRENVX V5,75 08/15/50	0,33
GS 3 03/15/24	2,64	MINGNO 3,125 12/22/25	0,38

Top 10 Emittenten mit der höchsten Kohlenstoffintensität

Fonds	Kohlenstoff- intensität (Tonnen CO ² /Mio. USD Umsatz)	Benchmark	Kohlenstoff- intensität (Tonnen CO ² /Mio. USD Umsatz)
ENBCN 2.5 02/14/25	435,04	TAQAUH 3,875 05/06/24 REGS	17.495,37
UNP 3.15 03/01/24	434,13	NTPCIN 3,75 04/03/24 EMTN	16.618,33
KFW 0 04/02/24 EMTN	101,09	HNINTL 2,25 02/20/25	12.309,68
NESNVX 0 11/12/24 EMTN	69,49	SMGRIJ 9 05/28/24 OB	11.445,36
TMUS 3.5 04/15/25	41,07	SECO 4 04/08/24 REGS	10.060,02
AMZN 0.45 05/12/24	34,44	SECO 4,222 01/27/24	10.060,02
RENAUL 2 07/11/24 EMTN	20,87	GDHJIN 1,875 06/23/25	9.756,83
BMW 0.5 02/22/25 emtn	19,85	GDYUDE 3 06/12/24	9.756,83
SANFP 0.875 04/06/25	19,32	VST 3,55 07/15/24 144A	8.269,14
AER 1.65 10/29/24	18,84	CPXCN 4,284 09/18/24 MTN	7.475,37

Angaben zu Risiken

- Eine Anlagehebelung tritt auf, wenn das wirtschaftliche Engagement größer als der investierte Betrag ist, z. B. bei der Verwendung von Derivaten. Ein Fonds, der eine Hebelung einsetzt, kann aufgrund des Verstärkungseffekts bei einer Preisänderung der Referenzquelle höhere Gewinne und/oder Verluste erfahren.
- Weitere Informationen zu den potenziellen Risiken finden Sie in den wesentlichen Anlegerinformationen und/oder im Prospekt bzw. Emissionsprospekt.

Index-Haftungsausschluss

BLOOMBERG® ist ein Warenzeichen und eine Dienstleistungsmarke der Bloomberg Finance L.P. und ihren verbundenen Unternehmen (zusammen "Bloomberg"). BARCLAYS® ist ein Warenzeichen und eine Dienstleistungsmarke der Barclays Bank Plc (zusammen mit ihren verbundenen Unternehmen, "Barclays"), verwendet unter Lizenz. Bloomberg oder Bloomberg's Lizenzgeber, einschließlich Barclays, besitzen alle Eigentumsrechte an den Bloomberg Barclays Indizes. Weder Bloomberg noch Barclays genehmigen oder billigen dieses Material, oder garantieren die Richtigkeit oder Vollständigkeit der hierin enthaltenen Informationen oder machen jegliche ausdrückliche oder stillschweigende Gewährleistung hinsichtlich der daraus zu erzielenden Ergebnisse und, soweit gesetzlich zulässig, übernehmen keinerlei Haftung für Verletzungen oder damit verbundenen Schäden.

Quelle: MSCI. Die MSCI-Informationen dürfen nur für Ihren internen Gebrauch verwendet werden, dürfen in keiner Weise vervielfältigt oder weiterverbreitet und nicht als Grundlage für oder als Komponente von Finanzinstrumenten, -produkten oder -indizes herangezogen werden. Keine der MSCI-Informationen ist dazu bestimmt, als Anlageberatung oder Empfehlung für (oder gegen) jegliche Art von Anlageentscheidung zu dienen und kann daher nicht als solche herangezogen werden. Historische Daten und Analysen sollten nicht als Maßstab oder Garantie für zukünftige Performance-Analysen, -Prognosen oder -Vorhersagen angesehen werden. Die MSCI-Informationen werden ohne Haftung und Gewähr zur Verfügung gestellt, wer diese Informationen nutzt, trägt das gesamte Risiko der Nutzung dieser Informationen. MSCI, jedes seiner verbundenen Unternehmen und jede weitere an der Erfassung, Berechnung oder Erstellung von MSCI-Informationen beteiligte oder damit befasste Person (zusammen die „MSCI-Parteien“) lehnt ausdrücklich alle Zusicherungen (einschließlich, ohne einschränkende Wirkung, jede Garantie der Ursprünglichkeit, Richtigkeit, Vollständigkeit, Aktualität, der Wahrung von Eigentumsrechten, Marktgängigkeit und Eignung für einen bestimmten Zweck) hinsichtlich dieser Informationen ab. Ohne dass das Vorgenannte dadurch eingeschränkt wird, haften die MSCI-Parteien keinesfalls in irgendeiner Weise für unmittelbare, mittelbare, konkrete, Folgeschäden oder irgendwelche sonstigen Schäden oder für Schadensersatzleistungen mit Strafcharakter (einschließlich entgangener Gewinne). (www.msci.com)

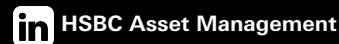
Wichtige Informationen

Das hierin enthaltene Material dient nur zu Marketingzwecken und zu Ihrer Information. Dieses Dokument ist weder vertraglich bindend noch sind wir verpflichtet, es Ihnen durch eine gesetzliche Bestimmung zur Verfügung zu stellen. Es stellt weder eine Rechts-, Steuer- oder Anlageberatung noch eine Empfehlung an die Leser dieses Materials zum Kauf oder Verkauf von Anlagen dar. Sie dürfen sich daher bei Anlageentscheidungen nicht auf den Inhalt dieses Dokuments stützen.

Die Informationen in diesem Dokument beruhen auf externen Quellen, die wir für zuverlässig halten, aber keiner neutralen Prüfung unterzogen haben. Wir übernehmen weder Gewähr noch Haftung für die Richtigkeit und Vollständigkeit der Informationen. Die in diesem Dokument vertretenen Meinungen stellen ausschließlich die Auffassungen des Autors/der Autoren dar und können sich jederzeit ändern; solche Meinungsänderungen müssen nicht publiziert werden. Der Fonds ist nicht für jeden Anleger geeignet. Es ist möglich, dass der Anleger bei Investment in diesen Fonds einen Verlust, auch bis zur Höhe seines gesamten Investments, erleidet. Die Informationen ersetzen nicht den allein maßgeblichen Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen und aktuellen Jahres- und Halbjahresberichte. Diese erhalten Sie kostenlos bei der HSBC Trinkaus & Burkhardt GmbH, Hansaallee 3, 40549 Düsseldorf sowie unter www.assetmanagement.hsbc.de. Weitere Informationen finden Sie im Prospekt.

Quelle: HSBC Asset Management, Daten zum 31 Dezember 2022

Follow us on:



Telefon: +49 (0) 211 910 4784 E-Mail: fonds@hsbc.de Website: www.etf.hsbc.com

Für weitere Informationen kontaktieren Sie uns bitte Tel: +49 (0)211 910 4784. Webseite: www.assetmanagement.hsbc.de/de

Glossar

